

Fecha de Publicación: 1 de julio de 2015

Fecha de Información: 26 de junio de viernes ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1265.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	400.3	127.5	76.0	295.0	19.1	72.9	32.4
15-35	257.2	448.8	336.8	67.8	18.7	96.0	93.4
36-60	29.8	52.8	0.0	0.0	52.8	29.8	0.0
61-90	10.6	7.5	0.0	0.0	7.5	10.6	0.0
91-180	10.6	9.6	0.0	0.0	9.6	10.6	0.0
>180	36.2	23.7	0.0	10.0	0.7	3.2	23.0
Total	744.6	670.0	412.8	372.8	108.4	222.9	148.9

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y operaciones con los otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

Cuadro No. 2

Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3.6 %	3.1 %	2.5 %	2.8 %
15-35	2.0 %	3.6 %	3.6 %	3.2 %
36-60	-	3.8 %	3.0 %	3.5 %
61-90	-	4.9 %	3.5 %	4.1 %
91-180	-	4.5 %	3.0 %	3.7 %
>180	3.8 %	4.3 %	3.4 %	3.6 %
Total	2.6 %	3.6 %	2.9 %	3.1 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

¹ Datos provisionales.

² El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado)^\wedge (360/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	22 al 26 de junio				29 de jun. al 3 de julio				6 al 10 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	35	83	4206	4275	11	58	3199	3478	20	96	2677	2962
Intragruppo y off-shore***	0	0	2348	1485	0	0	2128	1284	0	0	1619	958
Otros	83	35	745	1539	58	11	425	990	96	20	750	1126
Total	118	118	7299	7299	69	69	5751	5751	116	116	5046	5046

* Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

**Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.